



信达期货
CINDA FUTURES

国债期货早报20161205

联系人: 吕洁 F0269991 邵菁菁 F3014625

电话: 0571-28132630

邮箱: jingjing_shao@yahoo.com

要闻	1、又一只黑天鹅落地: 意大利公投失败 总理提出辞职 欧元暴跌 2、重拳调控之下 住宅成交近21个月来首现同比下滑 3、以国家安全为由 奥巴马阻止中资收购德企爱思强 4、刘士余: 全面加强资产管理行业监管 坚决查处触碰底线的行为				
SHIBOR		12/1/16	12/2/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	2.325	2.320	-0.50	-0.22%
	1W	2.502	2.501	-0.10	-0.04%
	2W	2.653	2.658	0.50	0.19%
	1M	2.893	2.916	2.33	0.81%
	3M	3.056	3.069	1.30	0.43%
CNH HIBOR		12/1/16	12/2/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	O/N	4.82	7.16	234.00	48.55%
	1W	4.68	7.05	237.00	50.64%
	2W	4.65	6.63	198.00	42.58%
银行间 同业拆借 利率		12/1/16	12/2/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1D	2.362	2.380	1.81	0.77%
	7D	2.943	2.604	-33.90	-11.52%
	14D	3.239	3.103	-13.60	-4.20%
	1M	3.467	3.988	52.04	15.01%
银行间 质押回购 利率		12/1/16	12/2/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	R001	2.426	2.326	-10.02	-4.13%
	R007	3.258	2.735	-52.30	-16.05%
	R014	3.611	3.173	-43.82	-12.13%
	R1M	3.400	3.050	-35.06	-10.31%
上交所 质押回购 利率		12/1/16	12/2/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	GC001	10.295	2.940	-735.50	-71.44%
	GC003	4.050	0.490	-356.00	-87.90%
	GC007	3.520	2.970	-55.00	-15.63%
国债到期 收益率		12/1/16	12/2/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	1Y	2.3270	2.3509	2.39	1.03%
	3Y	2.6437	2.6632	1.95	0.74%
	5Y	2.7839	2.7892	0.53	0.19%
	7Y	2.9662	2.9858	1.96	0.66%
	10Y	2.9893	2.9895	0.02	0.01%
	20Y	3.2759	3.2786	0.27	0.08%
	30Y	3.3778	3.3829	0.51	0.15%
票据利率		12/1/16	12/2/16	涨跌(BP)	涨跌幅度
	转贴6M	2.95	2.90	-5.00	-1.69%
	珠三角6M	3.10	3.05	-5.00	-1.61%
	长三角6M	3.05	3.00	-5.00	-1.64%
	中西部6M	3.15	3.10	-5.00	-1.59%
	环渤海6M	3.20	3.15	-5.00	-1.56%

国债期货 行情回顾		收盘价	持仓量	成交量	涨跌幅度
	TF1612	100.940	750	153	0.02%
	TF1703	99.770	21845	10100	-0.01%
	TF1706	99.320	2894	308	-0.03%
	T1612	100.020	372	0	0.62%
	T1703	98.255	51047	39100	0.06%
	T1706	97.440	7872	2425	0.10%
最廉券		CTD	净价	IRR	基差
	TF1612	160015. IB	99.3503	5.47%	-0.0855
	TF1703	160015. IB	99.3503	-0.88%	0.9873
	TF1706	160015. IB	99.3503	0.09%	1.3515
	T1612	160010. IB	99.0213	8.92%	-0.1785
	T1703	160010. IB	99.0213	-2.65%	1.5523
	T1706	160010. IB	99.0213	-1.55%	2.3413
持仓建议	资金面延续紧张态势，近期期债创出上市以来最大跌幅。全球通胀预期抬头且12月美联储加息预期进一步升温，资本外流和人民币汇率贬值压力加大，叠加国内房地产市场调控，政策重点亦转向抑制资产泡沫，短期货币政策难松，利空期债，预计期债弱势或将延续。				
报告中的信息均来源于公开可获得的资料，信达期货有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。未经信达期货有限公司授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播本报告的行为均可能承担法律责任。					